

Fecha de publicación: 28 de Enero de 2004  
 Fecha de Información: 26 de Enero de 2004 <sup>1</sup>

### INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$95.9 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 7.8%.<sup>2</sup>

**Cuadro No. 1**  
**Contratos Forwards Pactados**

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	35.5	29.6	4.1	10.0	39.5
15-35	17.5	25.5	14.5	6.5	32.0
36-60	6.0	6.1	0.1	-	6.1
61-90	0.4	0.0	0.0	0.4	0.4
91-180	2.6	0.3	0.3	2.6	2.8
>180	12.0	3.0	3.0	12.0	15.0
<b>Total</b>	<b>73.9</b>	<b>64.4</b>	<b>21.9</b>	<b>31.4</b>	<b>95.9</b>

\* Cifras en millones de dólares

**Cuadro No. 2**  
**Devaluación Implícita Anualizada**

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	8.3 %	9.1 %
15-35	6.2 %	7.3 %
36-60	6.6 %	6.2 %
61-90	-1.5 %	-0.4 %
91-180	6.1 %	4.0 %
>180	5.0 %	6.8 %
<b>Total</b>	<b>7.0 %</b>	<b>7.8 %</b>

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.<sup>3</sup>

**Cuadro No. 3**  
**Vencimientos de Forwards**

Sectores	26 al 30 de Enero				2 al 6 de Febrero				9 al 13 de Febrero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Financiero</b>	45	57	348	340	23	56	464	297	11	46	222	137
<b>Real</b>	35	23	142	150	43	10	71	237	43	8	89	175
<b>Total</b>	80	80	490	490	66	66	534	534	54	54	311	311

\* Cifras en millones de dólares

<sup>1</sup> Datos provisionales.

<sup>2</sup> La fórmula para la devaluación implícita es: ((Tasa Pactada/Promedio SET FX) ^ (Plazo/365)) - 1

<sup>3</sup> A partir del 27 de enero se presenta la proyección de vencimientos.